

東京海上・再生可能 エネルギー・インカム戦略 ファンド（毎月決算型） ＜愛称 グリーンパワーシフト＞

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2021年6月15日から2030年11月15日	
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)	「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	日本を含む世界の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)	<ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	<p>毎決算時に、原則として経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。</p>	

運用報告書（全体版）

第18期（決算日 2022年12月15日）
 第19期（決算日 2023年1月16日）
 第20期（決算日 2023年2月15日）
 第21期（決算日 2023年3月15日）
 第22期（決算日 2023年4月17日）
 第23期（決算日 2023年5月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
 さて、「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド（毎月決算型）＜愛称 グリーンパワーシフト＞」は、このたび、第23期の決算を行いましたので、第18期～第23期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
 今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			株 組 入 比	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 総 額
		税 分 配	達 配 金	期 騰 落 中 率			
(設定日)	円		円		%	%	百万円
2021年6月15日	10,000		—		—	—	250
1期(2021年7月15日)	9,978		0	△ 0.2	79.2	15.4	658
2期(2021年8月16日)	10,116		0	1.4	79.3	15.9	818
3期(2021年9月15日)	10,149		20	0.5	81.3	15.2	940
4期(2021年10月15日)	10,374		20	2.4	80.3	15.3	981
5期(2021年11月15日)	10,610		20	2.5	81.5	15.0	1,055
6期(2021年12月15日)	9,965		20	△ 5.9	80.5	15.4	1,134
7期(2022年1月17日)	9,720		20	△ 2.3	80.5	16.1	1,190
8期(2022年2月15日)	9,401		20	△ 3.1	80.5	15.8	1,150
9期(2022年3月15日)	10,190		20	8.6	81.3	15.4	1,220
10期(2022年4月15日)	11,029		70	8.9	81.5	14.7	1,259
11期(2022年5月16日)	10,195		70	△ 6.9	80.8	15.7	1,306
12期(2022年6月15日)	10,445		70	3.1	80.8	15.2	1,360
13期(2022年7月15日)	10,946		70	5.5	81.5	13.9	1,285
14期(2022年8月15日)	11,523		70	5.9	81.3	14.7	1,438
15期(2022年9月15日)	11,760		70	2.7	78.8	15.7	1,643
16期(2022年10月17日)	9,775		70	△16.3	79.6	17.1	1,475
17期(2022年11月15日)	10,247		70	5.5	79.6	13.8	1,606
18期(2022年12月15日)	10,298		70	1.2	83.5	14.5	1,713
19期(2023年1月16日)	9,467		70	△ 7.4	82.7	14.7	1,629
20期(2023年2月15日)	9,422		70	0.3	82.7	15.2	1,659
21期(2023年3月15日)	9,290		70	△ 0.7	83.4	14.4	1,654
22期(2023年4月17日)	9,429		70	2.2	83.3	14.2	1,727
23期(2023年5月15日)	9,315		70	△ 0.5	83.0	14.2	1,724

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率		
第18期	(期 首) 2022年11月15日	円 10,247	% —		% 79.6	% 13.8
	11月末	10,156	△0.9		80.4	14.1
	(期 末) 2022年12月15日	10,368	1.2		83.5	14.5
第19期	(期 首) 2022年12月15日	10,298	—		83.5	14.5
	12月末	9,628	△6.5		81.6	14.4
	(期 末) 2023年1月16日	9,537	△7.4		82.7	14.7
第20期	(期 首) 2023年1月16日	9,467	—		82.7	14.7
	1月末	9,424	△0.5		81.4	15.2
	(期 末) 2023年2月15日	9,492	0.3		82.7	15.2
第21期	(期 首) 2023年2月15日	9,422	—		82.7	15.2
	2月末	9,405	△0.2		82.8	14.8
	(期 末) 2023年3月15日	9,360	△0.7		83.4	14.4
第22期	(期 首) 2023年3月15日	9,290	—		83.4	14.4
	3月末	9,379	1.0		82.6	14.4
	(期 末) 2023年4月17日	9,499	2.2		83.3	14.2
第23期	(期 首) 2023年4月17日	9,429	—		83.3	14.2
	4月末	9,321	△1.1		82.5	14.4
	(期 末) 2023年5月15日	9,385	△0.5		83.0	14.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

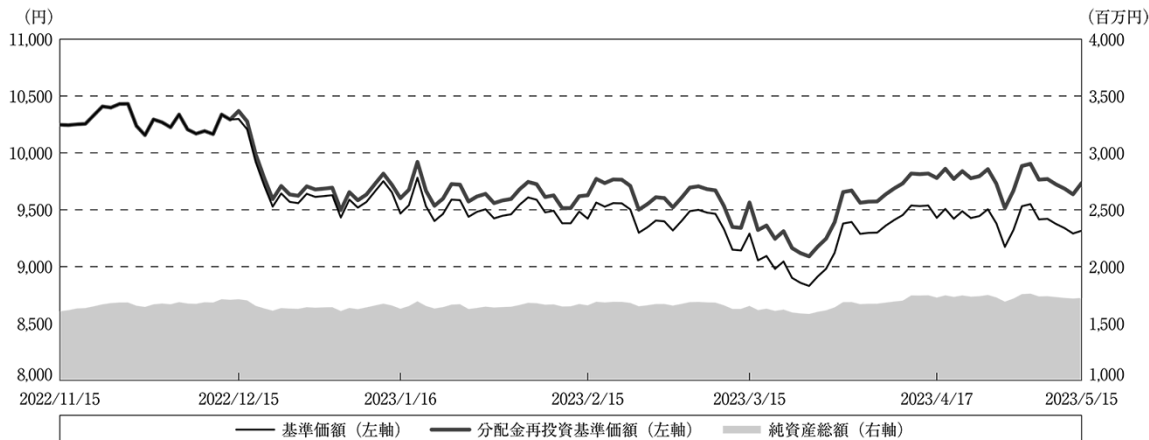
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

○運用経過

(2022年11月16日～2023年5月15日)

■作成期間中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2022年11月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有する再生可能エネルギー発電関連企業からの配当収入

マイナス要因

- ・インフレの高進と欧米中央銀行による積極的な金融引き締め政策による景気先行きへの懸念
- ・米ドルなどの保有通貨に対して円高が進行したこと

■投資環境

【世界株式市場】

当作成期、世界の株式市場は堅調な推移となりました。作成期前半は、インフレの高進から欧米中央銀行による積極的な金融引き締め姿勢が継続し、株式市場は軟調な展開となりましたが、その後はインフレのピークアウトに対する期待が高まり、一転して堅調な展開となりました。作成期後半は、インフレに対する根強い警戒感が残ったものの、新型コロナウイルス感染の沈静化を受けた経済活動の正常化などにより企業決算が改善するなか、株式市場は底堅い推移となりました。

【為替市場】

米ドル円為替レートは円高米ドル安となりました。作成期前半は、インフレのピークアウトに対する期待の高まりから米国長期金利が低下基調となったことを背景に円高米ドル安が進行しました。作成期後半は、米国地方銀行の相次ぐ経営破綻が円高要因となったものの、日銀が新総裁の下でも金融緩和政策を継続するとの見解を示したことが円安要因となり円安米ドル高基調となりましたが、前作成期末対比では円高米ドル安となりました。

ユーロ円為替レートは円安ユーロ高となりました。作成期前半はおおむね横ばいで推移しましたが、インフレ懸念が根強く残るなかで想定以上にECB(欧州中央銀行)による金融引き締め政策が継続するとの見方が高まり、作成期後半は円安ユーロ高が進行しました。

■ポートフォリオについて

＜東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)＞

「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、マザーファンドの値動きを反映し、5.0%下落しました。

＜東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド＞

再生可能エネルギー分野で、今後成長することが期待される企業をグローバルに調査し、厳選した上で投資しました。

当作成期、株式市場が堅調な展開となるなか、再生可能エネルギー発電関連企業は配当利回りの高い銘柄が多い公益関連企業を中心に、金利上昇の影響を受けて軟調な展開となりました。ESG投資に注目が集まるなか、再生可能エネルギー分野に長期投資の資金が流入するという流れに変化はないものの、世界的な金利上昇のなかで、配当利回りの高い株式に対する見方はネガティブなものとなりました。また、米ドルに対して円高が進行したこともマイナスに寄与しました。

以上のような運用の結果、基準価額は4.1%下落しました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■分配金

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期
	2022年11月16日～ 2022年12月15日	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	70 0.675%	70 0.734%	70 0.737%	70 0.748%	70 0.737%	70 0.746%
当期の収益	20	4	13	24	10	20
当期の収益以外	50	65	56	45	60	50
翌期繰越分配対象額	1,668	1,603	1,547	1,501	1,442	1,404

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型)>

「東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド>

ESGへの意識が世界的に高まるなか、環境に優しい再生可能エネルギーは成長分野として期待されています。再生可能エネルギーは、風力発電、太陽光発電、バイオマス発電など様々な形態がありますが、地球温暖化対策として二酸化炭素排出削減を目的に、再生可能エネルギーへのシフトは進んでいくとみています。また、電力などのエネルギーは安定的な需要があることから、安定した業績を反映して配当も安定している企業が多いことが一般的な特徴です。

欧米中央銀行による金融引き締め政策やロシアによるウクライナ侵攻の長期化といったニュースなどが投資家心理を左右し、株式市場のリスク要因となる可能性はありますが、安定した経営基盤のある再生可能エネルギー発電関連企業の株価は長期的には上昇していくとみています。

引き続き、再生可能エネルギー発電関連企業の株式等に投資を行い、配当収益と中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

○ 1万口当たりの費用明細

(2022年11月16日～2023年5月15日)

項 目	第18期～第23期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	85	0.886	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(47)	(0.491)	*委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(36)	(0.382)	*購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.014)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.018	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(2)	(0.016)	*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.002)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.015	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(1)	(0.012)	*有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.003)	
(d) そ の 他 費 用	5	0.055	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(5)	(0.049)	*保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.005)	*監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	93	0.974	
作成期間の平均基準価額は、9,552円です。			

(注) 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

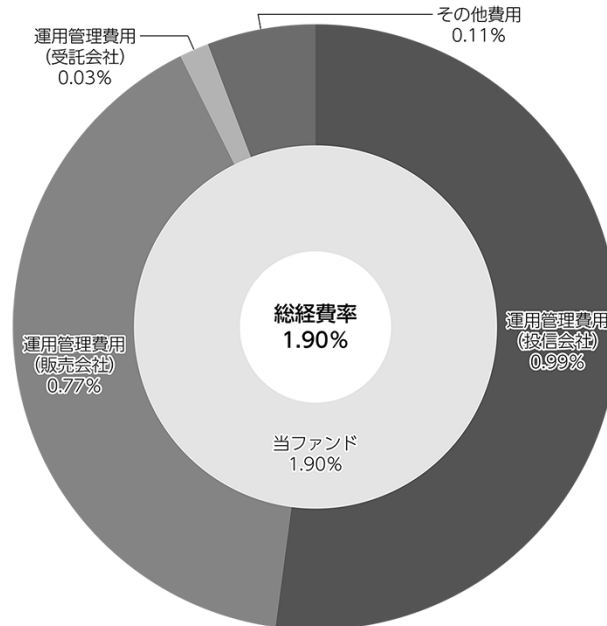
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.90%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年11月16日～2023年5月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第18期～第23期			
		設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド		294,943	319,969	123,557	132,282

○株式売買比率

(2022年11月16日～2023年5月15日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第18期～第23期	
	東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	341,259千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	1,873,271千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月16日～2023年5月15日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2023年5月15日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第17期末	第23期末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド		1,430,848	1,602,233	1,724,484

○投資信託財産の構成

(2023年5月15日現在)

項 目	第23期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド	1,724,484	99.0
コール・ローン等、その他	18,071	1.0
投資信託財産総額	1,742,555	100.0

(注) 東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(2,228,358千円)の投資信託財産総額(2,362,639千円)に対する比率は94.3%です。

(注) 外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当作成期末における邦貨換算レートは1米ドル=136.05円、1カナダドル=100.29円、1ユーロ=147.66円、1英ポンド=169.36円、1デンマーククローネ=19.83円、1豪ドル=90.53円、1ニュージーランドドル=84.30円、1香港ドル=17.35円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第18期末	第19期末	第20期末	第21期末	第22期末	第23期末
	2022年12月15日現在	2023年1月16日現在	2023年2月15日現在	2023年3月15日現在	2023年4月17日現在	2023年5月15日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,727,418,824	1,643,735,903	1,677,359,766	1,669,093,211	1,743,230,903	1,742,555,915
東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド(附属)	1,713,307,248	1,629,092,758	1,659,223,910	1,654,324,208	1,727,694,851	1,724,484,382
未収入金	14,111,576	14,643,145	18,135,856	14,769,003	15,536,052	18,071,533
(B) 負債	14,111,576	14,643,145	18,135,856	14,769,003	15,536,052	18,071,533
未払収益分配金	11,646,563	12,046,063	12,326,964	12,465,327	12,826,009	12,959,378
未払解約金	—	—	3,366,589	—	19,573	2,721,614
未払信託報酬	2,449,955	2,581,213	2,427,380	2,289,600	2,674,032	2,375,935
その他未払費用	15,058	15,869	14,923	14,076	16,438	14,606
(C) 純資産総額(A-B)	1,713,307,248	1,629,092,758	1,659,223,910	1,654,324,208	1,727,694,851	1,724,484,382
元本	1,663,794,831	1,720,866,195	1,760,994,946	1,780,761,072	1,832,287,068	1,851,339,764
次期繰越損益金	49,512,417	△ 91,773,437	△ 101,771,036	△ 126,436,864	△ 104,592,217	△ 126,855,382
(D) 受益権総口数	1,663,794,831口	1,720,866,195口	1,760,994,946口	1,780,761,072口	1,832,287,068口	1,851,339,764口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,298円	9,467円	9,422円	9,290円	9,429円	9,315円

(注) 当ファンドの第18期首元本額は1,567,907,106円、第18～23期中追加設定元本額は328,760,063円、第18～23期中一部解約元本額は45,327,405円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

項 目	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期
	2022年11月16日～ 2022年12月15日	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日
	円	円	円	円	円	円
(A) 有価証券売買損益	22,104,976	△125,000,786	6,604,537	△ 8,758,327	40,914,641	△ 5,817,810
売買益	22,270,021	173,407	7,365,382	4,720	41,884,038	39,722
売買損	△ 165,045	△125,174,193	△ 760,845	△ 8,763,047	△ 969,397	△ 5,857,532
(B) 信託報酬等	△ 2,465,013	△ 2,597,082	△ 2,442,303	△ 2,303,676	△ 2,690,470	△ 2,390,541
(C) 当期損益金(A+B)	19,639,963	△127,597,868	4,162,234	△ 11,062,003	38,224,171	△ 8,208,351
(D) 前期繰越損益金	△ 27,868,986	△ 11,540,109	△148,974,216	△157,088,492	△180,124,028	△142,899,593
(E) 追加信託差損益金	69,388,003	59,410,603	55,367,910	54,178,958	50,133,649	37,211,940
(配当等相当額)	(116,934,586)	(118,538,548)	(127,354,961)	(130,527,405)	(138,667,028)	(131,245,644)
(売買損益相当額)	(△ 47,546,583)	(△ 59,127,945)	(△ 71,987,051)	(△ 76,348,447)	(△ 88,533,379)	(△ 94,033,704)
(F) 計(C+D+E)	61,158,980	△ 79,727,374	△ 89,444,072	△113,971,537	△ 91,766,208	△113,896,004
(G) 収益分配金	△ 11,646,563	△ 12,046,063	△ 12,326,964	△ 12,465,327	△ 12,826,009	△ 12,959,378
次期繰越損益金(F+G)	49,512,417	△ 91,773,437	△101,771,036	△126,436,864	△104,592,217	△126,855,382
追加信託差損益金	61,069,029	59,410,603	55,367,910	54,178,958	39,139,927	27,955,241
(配当等相当額)	(108,776,403)	(118,622,564)	(127,422,614)	(130,556,721)	(127,704,868)	(122,045,385)
(売買損益相当額)	(△ 47,707,374)	(△ 59,211,961)	(△ 72,054,704)	(△ 76,377,763)	(△ 88,564,941)	(△ 94,090,144)
分配準備積立金	168,791,985	157,276,629	145,045,553	136,864,911	136,678,324	137,917,906
繰越損益金	△180,348,597	△308,460,669	△302,184,499	△317,480,733	△280,410,468	△292,728,529

(注) (A) 有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 信託財産の運用指図に係る権限の全部または一部を委託するために要した費用として、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対して年1万分の60の率を乗じて得た額を委託者報酬の中から支弁しています。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期
	2022年11月16日～ 2022年12月15日	2022年12月16日～ 2023年1月16日	2023年1月17日～ 2023年2月15日	2023年2月16日～ 2023年3月15日	2023年3月16日～ 2023年4月17日	2023年4月18日～ 2023年5月15日
a. 配当等収益(費用控除後)	4,675,733円	771,741円	2,394,769円	4,331,254円	2,018,368円	5,733,952円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	117,095,377円	118,622,564円	127,422,614円	130,556,721円	138,698,590円	131,302,084円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	167,443,841円	168,550,951円	154,977,748円	144,998,984円	136,492,243円	135,886,633円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	289,214,951円	287,945,256円	284,795,131円	279,886,959円	277,209,201円	272,922,669円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	1,738円	1,673円	1,617円	1,571円	1,512円	1,474円
g. 分配金	11,646,563円	12,046,063円	12,326,964円	12,465,327円	12,826,009円	12,959,378円
h. 分配金(1万円当たり)	70円	70円	70円	70円	70円	70円

○分配金のお知らせ

	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期
1万円当たり分配金(税込み)	70円	70円	70円	70円	70円	70円

(注) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2023年5月15日現在)

<東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド>

下記は、東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド全体(2,173,190千口)の内容です。

外国株式

銘柄	株数	第17期末		第23期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AVISTA CORP	76	86	380	51,762		公益事業
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	187	211	750	102,104		公益事業
CLEARWAY ENERGY INC-A	254	286	856	116,585		公益事業
ENPHASE ENERGY INC	25	28	475	64,624		半導体・半導体製造装置
IDACORP INC	39	44	481	65,541		公益事業
NEXTERA ENERGY INC	110	135	1,055	143,579		公益事業
SUNRUN INC	106	119	196	26,748		資本財
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS	216	243	645	87,788		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,015 8	1,155 8	4,841 —	658,735 <28.2%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	338	380	444	44,547		公益事業
BORALEX INC -A	169	190	727	72,947		公益事業
INNERGEX RENEWABLE ENERGY	152	171	229	22,981		公益事業
NORTHLAND POWER INC	192	217	635	63,770		公益事業
TRANSALTA RENEWABLES INC	507	619	742	74,479		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,360 5	1,579 5	2,779 —	278,726 <11.9%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ENCAVIS AG	258	290	463	68,390		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	258 1	290 1	463 —	68,390 <2.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
ERG SPA	104	117	320	47,397		公益事業
ACEA SpA	175	253	346	51,131		公益事業
ENEL SPA	589	812	492	72,689		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	869 3	1,183 3	1,159 —	171,217 <7.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
EDP Renovaveis SA	261	294	595	87,982		公益事業
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RTS	—	294	7	1,164		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	261 1	588 2	603 —	89,146 <3.8%>	
(ユーロ…オーストリア)						
VERBUND AG	59	66	509	75,197		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	59 1	66 1	509 —	75,197 <3.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	644	726	353	52,249		公益事業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	644 1	726 1	353 —	52,249 <2.2%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,092 7	2,855 8	3,089 —	456,202 <19.5%>	

銘柄	株数	第17期末		第23期末		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
(イギリス) SEVERN TRENT PLC Drax Group PLC	百株 127 756	百株 143 965	千英ポンド 420 578	千円 71,166 98,020	公益事業 公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	883 2	1,108 2	998 —	169,187 <7.2%>	
(デンマーク) ORSTED A/S	37	41	千デンマーククローネ 2,725	54,045	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	37 1	41 1	2,725 —	54,045 <2.3%>	
(オーストラリア) NEW ENERGY SOLAR LTD-NEW	5,767	5,767	千豪ドル 36	3,289	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,767 1	5,767 1	36 —	3,289 <0.1%>	
(ニュージーランド) CONTACT ENERGY LTD MERCURY NZ LTD MERIDIAN ENERGY LTD	958 1,042 1,552	1,254 1,174 2,001	千ニュージーランドドル 997 751 1,100	84,093 63,377 92,781	公益事業 公益事業 公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,554 3	4,430 3	2,849 —	240,252 <10.3%>	
(香港) CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H XINYI ENERGY HOLDINGS LTD Xinyi Energy Holdings RTS	1,610 1,520 6,940 —	2,590 — 10,740 1,074	千香港ドル 2,250 — 2,362 4	39,049 — 40,994 78	公益事業 資本財 公益事業 公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,070 3	14,404 3	4,618 —	80,122 <3.4%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,780 30	31,343 31	— —	1,940,562 <83.0%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄のく>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

国内投資信託証券

銘柄	口数	第23期末		
		口数	評価額	比率
カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人	618	660	千円 81,246	% 3.5
合計	618 銘柄数<比率>	660 1	81,246 <3.5%>	

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

外国投資信託証券

銘柄	第17期末	第23期末				
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	13,022	14,670	373	50,794	2.2	
小計	口数・金額	13,022	14,670	373	50,794	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.2%>	
(イギリス)			千英ポンド			
GREENCOAT UK WIND PLC	364,419	410,509	651	110,334	4.7	
RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR	379,298	427,269	528	89,584	3.8	
小計	口数・金額	743,717	837,778	1,180	199,918	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<8.5%>	
合計	口数・金額	756,739	852,448	—	250,713	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<10.7%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略マザーファンド

運用報告書 第2期 (決算日 2022年11月15日)

(計算期間 2021年11月16日～2022年11月15日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	騰 落 率	株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 券 率	純 資 産 額
(設定日) 2021年6月15日	円 10,000	% -		% -	% -	百万円 500
1期(2021年11月15日)	10,751	7.5		81.5	15.0	1,377
2期(2022年11月15日)	11,229	4.4		79.6	13.8	2,274

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	株 組 入 比	式 率	投 資 信 託 券 率
(期 首) 2021年11月15日	円 10,751	% -		% 81.5	% 15.0
11月末	10,407	△ 3.2		80.5	15.3
12月末	10,460	△ 2.7		80.2	15.3
2022年1月末	9,498	△ 11.7		80.7	16.0
2月末	9,992	△ 7.1		81.0	15.8
3月末	11,431	6.3		81.5	14.3
4月末	11,088	3.1		80.7	14.5
5月末	11,172	3.9		80.8	14.8
6月末	11,415	6.2		72.9	13.2
7月末	12,000	11.6		82.4	13.7
8月末	12,178	13.3		79.7	15.8
9月末	11,131	3.5		78.8	16.7
10月末	11,456	6.6		79.5	16.9
(期 末) 2022年11月15日	11,229	4.4		79.6	13.8

(注) 騰落率は期首比です。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○運用経過

(2021年11月16日～2022年11月15日)

■期中の基準価額等の推移

期首：10,751円
 期末：11,229円
 騰落率： 4.4%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有する再生可能エネルギー発電関連企業からの配当収入
- ・円安が進行したこと

マイナス要因

- ・インフレ高進を背景とした欧米中央銀行の積極的な金融引き締めによる景気の先行き懸念の高まり



■投資環境

【世界株式市場】

当期、世界の株式市場は下落しました。ロシアのウクライナ侵攻長期化などを受けて世界的に原油などコモディティ（商品）価格の上昇によるインフレが進行し、欧米中央銀行が積極的な金融引き締め政策を継続したことから景気の先行き懸念が高まり、株式市場は下落基調を強めました。

【為替市場】

当期の米ドル円為替レートは円安米ドル高となりました。インフレの高止まりを背景にFRB（米連邦準備制度理事会）が積極的な金融引き締め政策を実施した一方、日銀は金融緩和政策を維持し日米の金利差が拡大したことから、円安米ドル高が継続しました。期末にかけて、日銀による為替介入も実施されましたが、相場には一時的な影響に留まり、その後も円安米ドル高基調が継続しました。

ユーロ円為替レートは、インフレの進行を背景としたECB（欧州中央銀行）の金融引き締め政策に対して、日銀は金融緩和政策を維持したため、日欧の金利差拡大を背景に円安ユーロ高が継続しました。

■ポートフォリオについて

再生可能エネルギー分野で、今後成長することが期待される企業をグローバルに調査し、厳選した上で投資しました。

当期、株式市場全体の下落が再生可能エネルギー発電関連企業にとっても逆風となりました。期前半は、市場全体が上値の重い展開となるなか、世界的なESG投資の流れのなかで再生可能エネルギー発電関連企業への注目が継続したことから、株価は相対的に下値が堅い展開となりました。期後半は、インフレ高進を受けた欧米中央銀行の積極的な金融引き締めにより株式市場が軟調な展開となるなか、再生可能エネルギー関連企業の株価も軟調な展開となりました。一方、主要通貨に対して円安が進行したことはプラスに寄与しました。

以上のような運用の結果、基準価額は4.4%上昇しました。

○今後の運用方針

ESGへの意識が世界的に高まるなか、環境に優しい再生可能エネルギーは成長分野として期待されています。再生可能エネルギーは、風力発電、太陽光発電、バイオマス発電など様々な形態がありますが、地球温暖化対策として二酸化炭素排出削減を目的に、再生可能エネルギーへのシフトは進んでいくとみています。また、電力などのエネルギーは安定的な需要があることから、安定した業績を反映して配当も安定している企業が多いことが一般的特徴です。

欧米中央銀行による金融引き締め政策やロシアによるウクライナ侵攻、新型コロナウイルス関連のニュースなどが投資家心理を左右し、株式市場のリスク要因となる可能性はありますが、安定した経営基盤のある再生可能エネルギー発電関連企業の株価は長期的には上昇していくとみています。

引き続き、再生可能エネルギー発電関連企業の株式等に投資を行い、配当収益と中長期的な値上がり益の獲得をめざします。

○1万口当たりの費用明細

(2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	円 10 (8) (2)	% 0.093 (0.076) (0.017)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	6 (4) (2)	0.053 (0.037) (0.016)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 * 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	10 (10) (0)	0.088 (0.088) (0.000)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
合 計	26	0.234	
期中の平均基準価額は、11,019円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買及び取引の状況

(2021年11月16日～2022年11月15日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 597	千米ドル 2,811	百株 172	千米ドル 771
	カナダ	799	千カナダドル 1,923	183	千カナダドル 438
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	183	355	46	83
	イタリア	435	531	144	189
	フランス	21	83	65	327
	スペイン	181	411	46	103
	オーストリア	30	287	8	80
	ポルトガル	272	127	86	39
	イギリス	494	千英ポンド 502	269	千英ポンド 232
国	デンマーク	19	千デンマーククローネ 1,541	4	千デンマーククローネ 343
	オーストラリア	1,970	千豪ドル 162	1,004 (-)	千豪ドル 81 (-)
	ニュージーランド	1,508	千ニュージーランドドル 903	474	千ニュージーランドドル 270
	香港	3,624	千香港ドル 2,472	1,532	千香港ドル 1,129

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	タカラレーベン・インフラ投資法人	453	千円 50,992	737	千円 92,429
	カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人	366	45,463	69	8,443
	合 計	819	96,455	806	100,873
外	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	7,845	342	1,608	60
	小 計	7,845	342	1,608	60
国	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	GREENCOAT UK WIND PLC	234,504	359	75,961	115
	RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR	235,152	318	67,359	90
小 計	469,656	678	143,320	206	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○株式売買比率

(2021年11月16日～2022年11月15日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	1,398,887千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,509,505千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.92

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2021年11月16日～2022年11月15日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年11月15日現在)

外国株式

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AVISTA CORP	62	76	293	41,144	公益事業	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	110	187	593	83,359	公益事業	
CLEARWAY ENERGY INC-A	148	254	824	115,748	公益事業	
ENPHASE ENERGY INC	13	25	750	105,337	半導体・半導体製造装置	
IDACORP INC	27	39	398	55,990	公益事業	
NEXTERA ENERGY INC	59	110	899	126,250	公益事業	
SUNRUN INC	50	106	314	44,196	資本財	
ATLANTICA SUSTAINABLE INFRAS	117	216	589	82,786	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	590	1,015	4,663	654,814	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<28.8%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	153	338	358	37,801	公益事業	
BORALEX INC -A	80	169	660	69,572	公益事業	
INNERGEX RENEWABLE ENERGY	124	152	245	25,892	公益事業	
NORTHLAND POWER INC	112	192	755	79,604	公益事業	
TRANSALTA RENEWABLES INC	272	507	718	75,722	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	743	1,360	2,739	288,594	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<12.7%>	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ) ENCAVIS AG	百株 121	百株 258	千ユーロ 520	千円 75,310	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	121 1	258 1	520 —	75,310 <3.3%>	
(ユーロ…イタリア) ERG SPA ACEA SpA ENEL SPA	60 107 409	104 175 589	318 232 299	46,076 33,720 43,365	公益事業 公益事業 公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	577 3	869 3	850 —	123,161 <5.4%>	
(ユーロ…フランス) ALBIOMA SA	44	—	—	—	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	44 1	— —	— —	— <—%>	
(ユーロ…スペイン) EDP Renovaveis SA	125	261	571	82,729	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	125 1	261 1	571 —	82,729 <3.6%>	
(ユーロ…オーストリア) VERBUND AG	37	59	489	70,832	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	37 1	59 1	489 —	70,832 <3.1%>	
(ユーロ…ポルトガル) ENERGIAS DE PORTUGAL SA	458	644	284	41,201	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	458 1	644 1	284 —	41,201 <1.8%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,365 8	2,092 7	2,716 —	393,236 <17.3%>	
(イギリス) SEVERN TRENT PLC Drax Group PLC	66 591	127 756	千英ポンド 350 414	57,816 68,305	公益事業 公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	658 2	883 2	764 —	126,121 <5.5%>	
(デンマーク) ORSTED A/S	22	37	千デンマーククローネ 2,409	46,893	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	22 1	37 1	2,409 —	46,893 <2.1%>	
(オーストラリア) NEW ENERGY SOLAR LTD-NEW	4,801	5,767	千豪ドル 547	51,498	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,801 1	5,767 1	547 —	51,498 <2.3%>	
(ニュージーランド) CONTACT ENERGY LTD MERCURY NZ LTD MERIDIAN ENERGY LTD	636 731 1,152	958 1,042 1,552	千ニュージーランドドル 704 562 715	60,244 48,055 61,207	公益事業 公益事業 公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,520 3	3,554 3	1,982 —	169,508 <7.5%>	
(香港) CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,330 988	1,610 1,520	千香港ドル 1,577 1,214	28,274 21,763	公益事業 資本金	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	公益事業	
XINYI ENERGY HOLDINGS LTD	5,660	6,940	1,610	28,852		
小計	株数・金額	7,978	10,070	4,402	78,890	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<3.5%>	
合計	株数・金額	18,680	24,780	—	1,809,556	
	銘柄数<比率>	31	30	—	<79.6%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 小計、合計欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

国内投資信託証券

銘柄	口数	口数	期末		比率
			評価額	比率	
タカラレーベン・インフラ投資法人	284	—	千円	—	%
カナディアン・ソーラー・インフラ投資法人	321	618	78,362	3.4	—
合計	口数・金額	605	618	78,362	
	銘柄数<比率>	2	1	<3.4%>	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

外国投資信託証券

銘柄	口数	口数	期末		比率	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口数	口数	千米ドル	千円	%	
HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE	6,785	13,022	415	58,326	2.6	
小計	口数・金額	6,785	13,022	415	58,326	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.6%>	
(イギリス)			千英ポンド			
GREENCOAT UK WIND PLC	205,876	364,419	549	90,707	4.0	
RENEWABLES INFRASTRUCTURE GR	211,505	379,298	521	85,964	3.8	
小計	口数・金額	417,381	743,717	1,071	176,671	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<7.8%>	
合計	口数・金額	424,166	756,739	—	234,998	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<10.3%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○投資信託財産の構成

(2022年11月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,809,556	78.9
投資証券	313,360	13.7
コール・ローン等、その他	170,233	7.4
投資信託財産総額	2,293,149	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産(2,081,513千円)の投資信託財産総額(2,293,149千円)に対する比率は90.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=140.41円、1カナダドル=105.36円、1ユーロ=144.78円、1英ポンド=164.95円、1デンマーククローネ=19.46円、1豪ドル=93.99円、1ニュージーランドドル=85.50円、1香港ドル=17.92円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,293,149,637
コール・ローン等	83,453,900
株式(評価額)	1,809,556,818
投資証券(評価額)	313,360,926
未収入金	84,709,000
未収配当金	2,068,993
(B) 負債	18,823,908
未払解約金	18,823,800
未払利息	108
(C) 純資産総額(A-B)	2,274,325,729
元本	2,025,469,208
次期繰越損益金	248,856,521
(D) 受益権総口数	2,025,469,208口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,229円

(注) 当親ファンドの期首元本額は1,281,611,850円、期中追加設定元本額は1,625,627,942円、期中一部解約元本額は881,770,584円です。

<元本の内訳>

東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(毎月決算型) 1,430,848,060円

東京海上・再生可能エネルギー・インカム戦略ファンド(年1回決算型) 594,621,148円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

(2021年11月16日～2022年11月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	58,099,466
受取配当金	57,896,715
受取利息	220,150
その他収益金	1,173
支払利息	△ 18,572
(B) 有価証券売買損益	11,475,219
売買益	341,969,035
売買損	△330,493,816
(C) 保管費用等	△ 1,660,809
(D) 当期損益金(A+B+C)	67,913,876
(E) 前期繰越損益金	96,274,447
(F) 追加信託差損益金	207,141,761
(G) 解約差損益金	△122,473,563
(H) 計(D+E+F+G)	248,856,521
次期繰越損益金(H)	248,856,521

(注) (B) 有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F) 追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) (G) 解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。